

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 29 de junio de 2023
Fecha de Información: 27 de junio de 2023¹

Según el reporte de los Sistemas de Información y Registro de Operaciones sobre Divisas del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$4970 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.18%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	900,9	1039,2	533,4	586,4	283,8	92,5	222
15-35	1024,3	1025,1	582,5	570,7	88,6	99,6	354
36-60	560,2	216,5	182,8	253,5	13,7	286,7	20
61-90	4,5	20,6	14,0	3,5	6,6	1,0	0
91-180	65,5	233,0	155,3	44,0	62,6	6,5	15
>180	270,8	291,3	216,0	199,4	4,3	0,4	71
Total	2826,1	2825,7	1684,1	1657,4	459,6	486,7	682

^a Cifras en millones de dólares

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior

Cuadro No. 2 Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario ^a	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	12.19%	7.81%	9.02%	8.99%
15-35	12.26%	12.01%	12.02%	12.09%
36-60	10.54%	11.69%	10.01%	10.10%
61-90	–	10.16%	10.24%	10.17%
91-180	9.47%	9.50%	9.54%	9.50%
>180	7.56%	7.69%	7.20%	7.58%
Total	11.64%	9.41%	10.16%	10.18%

^a Incluye solo operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

¹A partir del 7 de diciembre se calcula este reporte incorporando la información preliminar reportada por los Sistemas de Información y Registro de Operaciones sobre divisas al Banco de la República.

²El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	26 – 30 jun.				03 - 07 jul.				10 - 14 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	34	247	10036	10955	32	155	3592	4657	81	217	5822	5390
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5167	4383	0	0	3157	1965	0	0	2971	2459
Otros ^c	247	34	1672	1537	155	32	542	670	217	81	437	1377
Total	281	281	16875	16875	187	187	7291	7292	298	298	9230	9226

^a Cifras en millones de dólares.

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.